**《应用金融1》课程教学大纲**

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **课程名称：应用金融1** | | | | | **课程类别（必修/选修）：专业必修** | | | | | |
| **课程英文名称：**Applied finance 1 | | | | | | | | | | |
| **总学时/周学时/学分：48/3/3** | | | | | **其中实验学时：18** | | | | | |
| **先修课程：微观经济学、宏观经济学** | | | | |  | | | | | |
| **授课时间：周一/1-3节** | | | | | **授课地点：实验楼** | | | | | |
| **授课对象：2019级经济与金融专业** | | | | | | | | | | |
| **开课院系：粤台产业科技学院经济与金融系** | | | | | | | | | | |
| **任课教师姓名/职称：谢松霖/副教授** | | | | | | | | | | |
| **联系电话：13539025375** | | | | | **Email:handsomesony@126.com** | | | | | |
| **答疑时间、地点与方式：周二, 周三全天/实验楼203办公室/面授与讨论** | | | | | | | | | | |
| **课程考核方式：**开卷**（）**闭卷**（）**课程论文**（）**其它**（√）** | | | | | | | | | | |
| **使用教材：**《风险管理与金融机构》，第4版，(加)约翰.赫尔，王勇译，机械工业出版社，2018年。  ISBN 9787111593362  **教学参考资料：**   1. Mutual Funds: Portfolio Structures, Analysis, Management, and Stewardship; John A. Haslem; Publisher: Wiley; 2009 2. Mishkin and Eakins (2015) Financial Markets and Institutions (GE), 8th Edition 3. 《Risk Management and Financial Institutions》，第四版， John C. Hull，约翰威立商务服务（北京）有限公司Wiley， 2014年。   2.《风险管理》，王周伟，机械工业出版社，2017年。 | | | | | | | | | | |
| **课程简介：**  本课程教学，以习近平中共中央总书记、国家主席、中央军委主席习近平总书记新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展为核心，培养学生金融机构从业人员专业能力，透过实践课程，了解证券业、银行业、私募、基金管理等金融机构公司的实际营运，装备学生需具备的专业知识，使学生将来能胜任这些金融机构的工作。证券业包含证券市场交易机制、有价证券募集与发行、集中市场、债券、市场投资分析等。银行业包含银行的负债业务、银行的资产业务、银行的表外业务、银行的资产负债管理、银行的营销管理、银行的风险管理、银行经营管理绩效评价。 | | | | | | | | | | |
| **课程教学目标**  1. 培养学生具备专门的投资管理知识（理解）。  2. 培养顶尖的金融风险控管人员以符合产业界之需求（综合）。  3. 培养学生应用风阾管理于公司与产业界的能力及专业态度（综合） | | | | | | **本课程与学生核心能力培养之间的关联(授课对象为理工科专业学生的课程填写此栏）：**  **■核心能力1.**  **■核心能力2.**  **■核心能力3.**  **■核心能力4.**  **■核心能力5.**  **■核心能力6.**  **■核心能力7．**  **■核心能力8．** | | | | |
| 理论教学进程表 | | | | | | | | | | |
| 周次 | 教学主题 | | 教学时长 | 教学的重点与难点 | | | | 教学方式 | | 作业安排 |
| 1 | 证券市场与证券公司业务介绍 | | 3 | 重点：证券市场与证券公司业务介绍  难点：证券公司实际运作方式  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习金证券市场与证券公司业务介绍 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 2 | 有价证券发行 | | 3 | 重点：各种有价证券种类发行  难点：各种有价券发行规定与条件  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习各种有价证券种类发行方式与规定 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 3 | 证券市场交易机制 | | 3 | 重点：各种有价证券种类与交易机制  难点：证券市场交易实际运作方式  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习金融市场各种有价证券种类与交易机制 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业一:证券市场研究报告 |
| 4 | 股票投资组合分析实务 | | 3 | 重点：股票投资组合分析  难点：股票报酬与风险衡量，风险分散  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习股票投资组合分析与风险分散 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 5 | 债券投资分析实务 | | 3 | 重点：债券评价  难点：存续期间与利率风险  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习股债券投资分析 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 6 | 基金投资分析实务 | | 3 | 重点：基金种类与投资策略  难点：基金风险衡量与绩效评估  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习基金投资 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 7 | 衍生性金融商品投资分析实务 | | 3 | 重点：股票期权定价、股票期权交易策略  难点：期权交易策略组合  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习衍生性金融商品的交易策略组合 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业二:有价证券投资研究报告 |
| 8 | 股票订价模型与投资实务 | | 3 | 重点：股票期权定价、股票期权交易策略  难点：期权交易策略组合  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习衍股票订价 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 9 | 期权订价模型与投资实务 | | 3 | 重点：期权订价模型与计算  难点：期权订价因子  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习期权订价 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 10 | 银行的负债业务实务 | | 3 | 重点：负债业务的概念、负债业务的运作、存款经营的策略  难点：存款创新、存款成本管理  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的负债业务 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 11 | 银行的资产业务实务 | | 3 | 重点：贷款业务操作规程  难点：贷款风险度和信用等级测算与评估、贷款信用调查分析方法  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的资产业务 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 12 | 银行的表外业务实务 | | 3 | 重点：中间业务及其相关性概念和框架  难点：创新业务  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的表外业务 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业三:银行业务研究报告 |
| 13 | 银行的资产负债管理实务 | | 3 | 重点：掌握商业银行资产负债管理理论的发展、利率敏感性缺口模型的运用  难点：利率敏感性缺口模型及久期技术  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的资产负债管理 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 14 | 银行的营销管理实务 | | 3 | 重点：商业银行风险的类别、管理、内部控制的目标、类型和方法  难点：客户分析方法、客户经理工作技能  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的营销管理 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 15 | 银行的风险管理实务 | | 3 | 重点：银行营销管理体系、客户分析方法、客户经理的工作技能  难点：商业银行风险预测  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的风险管理 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业四:银行风险管理研究报告 |
| 16 | 银行经营管理绩效评价实务 | | 3 | 重点：商业银行财务报表分析  难点：商业银行绩效评价方法  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行经营管理绩效评价 | | | | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 合计： | | | 48 |  | | | |  | |  |
| 实践教学进程表 | | | | | | | | | | |
| 周次 | 实验项目名称 | | 学时 | 重点与难点 | | | 项目类型（验证/综合/设计） | 教学  方式 | | 作业安排 |
| 3 | 证券市场交易机制 | | 3 | 重点：各种有价证券种类与交易机制  难点：证券市场交易实际运作方式  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习金融市场各种有价证券种类与交易机制 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业一:证券市场研究报告 |
| 4 | 股票投资组合分析实务 | | 3 | 重点：股票投资组合分析  难点：股票报酬与风险衡量，风险分散  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习股票投资组合分析与风险分散 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 6 | 基金投资分析实务 | | 3 | 重点：基金种类与投资策略  难点：基金风险衡量与绩效评估  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习基金投资 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 7 | 衍生性金融商品投资分析实务 | | 3 | 重点：股票期权定价、股票期权交易策略  难点：期权交易策略组合  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习衍生性金融商品的交易策略组合 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业二:有价证券投资研究报告 |
| 8 | 股票订价模型与投资实务 | | 3 | 重点：股票期权定价、股票期权交易策略  难点：期权交易策略组合  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习衍股票订价 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 9 | 期权订价模型与投资实务 | | 3 | 重点：期权订价模型与计算  难点：期权订价因子  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习期权订价 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 12 | 银行的表外业务实务 | | 3 | 重点：中间业务及其相关性概念和框架  难点：创新业务  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的表外业务 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业三:银行业务研究报告 |
| 14 | 银行的营销管理实务 | | 3 | 重点：商业银行风险的类别、管理、内部控制的目标、类型和方法  难点：客户分析方法、客户经理工作技能  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的营销管理 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | |  |
| 15 | 银行的风险管理实务 | | 3 | 重点：银行营销管理体系、客户分析方法、客户经理的工作技能  难点：商业银行风险预测  课程思政融入点：以习近平新时代中国特色社会主义经济思想指导金融发展，学习银行的风险管理 | | | 综合 | 课堂讲授/小组讨论 | | 作业四:银行风险管理研究报告 |
| 合计： | | | 27 |  | | |  |  | |  |
| 成绩评定方法及标准 | | | | | | | | | | |
| 考核内容 | | 评价标准 | | | | | | | 权重 | |
| 到堂情况 | | 不迟到、不早退、不旷课 | | | | | | | 0.1 | |
| 平时作业 | | 根据评分标准评定分数 | | | | | | | 0.6 | |
| 期末报告 | | 根据评分标准评定分数 | | | | | | | 0.3 | |
| 大纲编写时间：2019-08-30 | | | | | | | | | | |
| **系（部）审查意见：**  我系（专业）已对本课程教学大纲进行了审查，同意执行  谢松霖  系（部）主任签名： 日期： 年 月 日 | | | | | | | | | | |

注：1、课程教学目标：请精炼概括3-5条目标，并注明每条目标所要求的学习目标层次（理解、运用、分析、综合和评价）。本课程教学目标须与授课对象的专业培养目标有一定的对应关系

2、学生核心能力即毕业要求或培养要求，请任课教师从授课对象人才培养方案中对应部分复制（http://jwc.dgut.edu.cn/）

3、教学方式可选：课堂讲授/小组讨论/实验/实训

4、若课程无理论教学环节或无实践教学环节，可将相应的教学进度表删掉。